

2013年2月運用報告書(2013年2月1日～2013年2月28日)

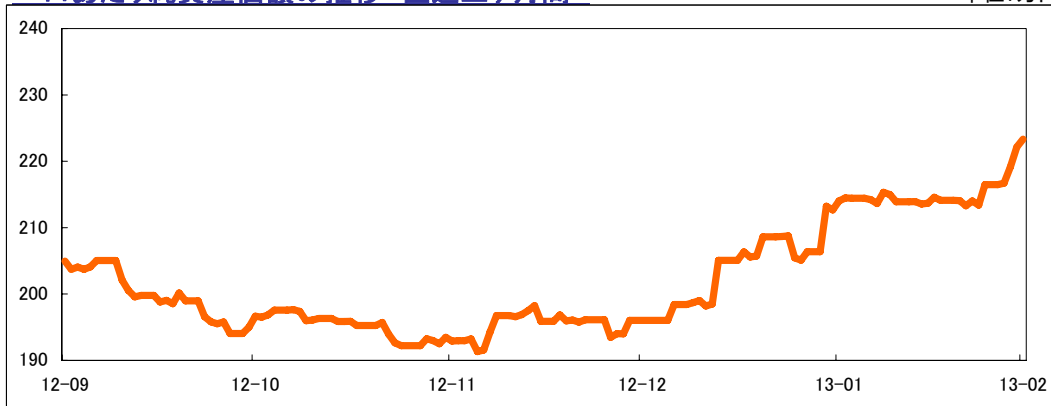
純資産の推移(一口=百万円)

【年平均騰落率：8.76%】

	設定時 (1999/2/1)	2012年10月末	2012年11月末	2012年12月末	2013年1月末	2013年2月末
1口あたりの 純資産価額(円)	1,000,000	1,965,212	1,929,301	1,960,211	2,144,728	2,233,360
月次騰落率	—	-4.11%	-1.83%	1.60%	9.41%	4.13%
設定来騰落率	—	96.52%	92.93%	96.02%	114.47%	123.34%

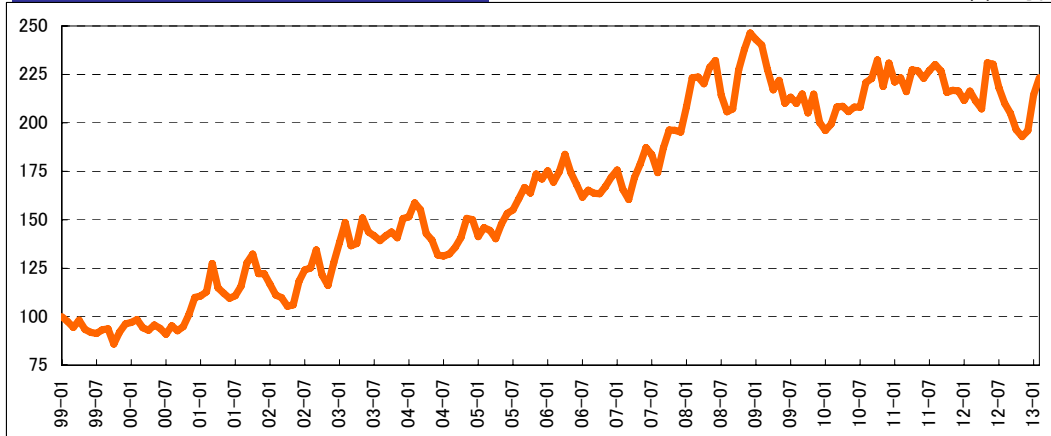
一口あたり純資産価額の推移 直近五ヶ月間

単位：万円



一口あたり純資産価額の推移 設定来

単位：万円



各セクターごとの損益

2013年2月の運用成績はプラスとなり、アセットトライは前月比4.13%の利益となりました。

通貨・為替	金利	株価指数	エネルギー	金属	農産物	その他商品
++	++	++	+	--	+	+

(注) +は利益、-は損失、その数が損益の大きさを表しています。

マーケット概要

為替相場は、米ドルが対ユーロではドル高傾向となり、ポンド、豪ドルの下落もあって、ドル全面高となりました。円相場は概ね92～94円での横ばい推移となり、イタリアでの選挙結果を背景に91円を割り込むなど短期的に大きく振れる場面も見られました。日銀総裁人事や今後のイタリア政局への不透明感や欧州での債務危機問題の対応が一段と厳しさを増したとの見方から、不安定な動きとなりました。

主要国の短期金利は、日米欧ともに低金利政策を維持するなか低水準での横ばいとなり、スイスではマイナス金利も見られました。長期金利は、総選挙後のイタリア債務問題再燃が懸念されて上昇する場面があったものの、主要国では金融緩和維持のスタンスを示したことから月末にかけては低下傾向。国内では10年債利回りが2003年6月以来の低水準となりました。

主要国の株価指数は、1月までの急な上昇基調から横ばい推移となりました。日経平均は2008年9月以来の11,500円を、NYダウは2007年10月以来の14,000ドルを回復したものの、中国の成長鈍化、イタリアの政局不安、米国の歳出強制削減の実行もあって伸び悩み。新興国市場では、中国株が旧正月明けに不動産規制強化が見込まれ、月末にかけて軟調となりました。

原油相場は、当初の上昇基調から反落しました。ブレント原油は116ドル水準から119ドルへ上昇したものの、欧州や中国経済の成長鈍化から2013年の石油需要見通しが下方修正されると反落。25日イタリア総選挙から債務問題の再燃が懸念されたほか、冬場の需要期が終盤に向かう中での需給緩和、米国での原油在庫積上げなどから月末は111ドルへ下落しました。

金相場は当初の1,665ドルから一貫して下落傾向となりました。1,650ドル割れで下落が加速し、一時は1,560ドル割れの場面も見られました。短期買いポジションの利益確定売りが先行しつつ、米国では個人消費の強さを確認して株価が堅調に推移。金融緩和が当初見込みよりも早期に終了するとの見方が台頭したこともあり、金ETFは100トン規模の解消売りが先行しました。

《投資家の皆様へ》1999年3月以降に追加出資された方は、取得口数が参加時期により異なりますので、別添の募集月別のアセットトライ評価額一覧表にてご自身の損益をご確認ください。

【お問合せ先】岡藤商事株式会社 コールセンター

フリーコール：0120-33-7639(受付時間：土日祝日を除く平日8:30～17:00)

E-mail：center@okato.co.jp Web site：http://www.shouhin-fund.com/index.html#assettry

◆当資料は金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。◆騰落率の数値は、運用開始日の1口当たりの純資産価額(¥1,000,000)を基準に算出しています。(小数点以下第3位を四捨五入)。◆当ファンドの運用成績は過去の実績に基づいたものであり、将来の運用成績を保証するものではありません。◆当ファンドの純資産価額は運用対象である商品、有価証券、通貨、金利等の先物取引や現物取引などの値動きの影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。◆当資料は当ファンドの受益者へ情報を提供することのみを目的としたものであり、ここに記載される商品の売却や購入について勧誘するものではありません。◆当ファンドは円建の積極運用追加型商品ファンドです。

■アセットトレイ / 評価額一覧表(評価日: 2013年2月28日時点)

評価日	2013/2/28
純資産価値	2,233,360 ...①

※取得口数通知書内、記載の『契約コード』の上6桁をご覧ください。
 ※評価額(時価)⑤ = 純資産価値① × 取得口数④
 ※平均年率⑧ = 運用開始来騰落率 ÷ (運用日数 ÷ 365)

※損益率の数値は、運用開始日の純資産価値(¥1,000,000)を基準に算出しています。(小数点以下第3位を四捨五入)。運用実績は過去の
 実績であり将来の収益を示すものではありません。また一定の利回りを金融商品取引業者および営業者が保証しているものではありません。

契約コード	運用期間	運用開始時			評価日時点					
		運用開始日	期間(月)	投資単位 ②	純資産価値 ③	取得口数 ④	評価額(時価)	評価損益	損益率	年率
							⑤=①×④	⑥=⑤-②	⑦=⑤÷②	⑧
1	AT9901	1999/2/1	169ヵ月	1,000,000	1,000,000	1,000,000	2,233,360	1,233,360	223.34%	8.75%
2	AT9902	1999/3/1	168ヵ月	1,000,000	975,824	1,024,775	2,288,691	1,288,691	228.87%	9.20%
3	AT9903	1999/4/1	167ヵ月	1,000,000	944,967	1,058,238	2,363,426	1,363,426	236.34%	9.79%
4	AT9904	1999/5/6	166ヵ月	1,000,000	982,246	1,018,074	2,273,725	1,273,725	227.37%	9.20%
5	AT9905	1999/6/1	165ヵ月	1,000,000	934,053	1,070,603	2,391,041	1,391,041	239.10%	10.11%
6	AT9906	1999/7/1	164ヵ月	1,000,000	919,230	1,087,867	2,429,598	1,429,598	242.96%	10.45%
7	AT9907	1999/8/2	163ヵ月	1,000,000	913,373	1,094,842	2,445,176	1,445,176	244.52%	10.63%
8	AT9908	1999/9/1	162ヵ月	1,000,000	932,986	1,071,930	2,394,005	1,394,005	239.40%	10.32%
9	AT9909	1999/10/1	161ヵ月	1,000,000	937,090	1,067,133	2,383,292	1,383,292	238.33%	10.30%
10	AT9910	1999/11/1	160ヵ月	1,000,000	858,762	1,164,466	2,600,671	1,600,671	260.07%	12.00%
11	AT9911	1999/12/1	159ヵ月	1,000,000	920,742	1,086,800	2,425,607	1,425,607	242.56%	10.75%
12	AT9912	2000/1/4	158ヵ月	1,000,000	962,909	1,038,519	2,319,386	1,319,386	231.94%	10.02%
13	AT2001	2000/2/1	157ヵ月	1,000,000	970,254	1,030,657	2,301,828	1,301,828	230.18%	9.95%
14	AT2002	2000/3/1	156ヵ月	1,000,000	985,675	1,014,533	2,265,817	1,265,817	226.58%	9.73%
15	AT2003	2000/4/3	155ヵ月	1,000,000	943,349	1,060,053	2,367,479	1,367,479	236.75%	10.58%
16	AT2004	2000/5/1	154ヵ月	1,000,000	930,228	1,075,005	2,400,873	1,400,873	240.09%	10.91%
17	AT2005	2000/6/1	153ヵ月	1,000,000	957,390	1,044,506	2,332,757	1,332,757	233.28%	10.45%
18	AT2006	2000/7/1	152ヵ月	1,000,000	939,723	1,064,413	2,376,614	1,376,614	237.66%	10.86%
19	AT2007	2000/8/1	151ヵ月	1,000,000	909,246	1,099,812	2,456,276	1,456,276	245.63%	11.57%
20	AT2008	2000/9/1	150ヵ月	1,000,000	953,190	1,049,108	2,343,035	1,343,035	234.30%	10.74%
21	AT2009	2000/10/1	149ヵ月	1,000,000	927,899	1,077,703	2,406,898	1,406,898	240.69%	11.33%
22	AT2010	2000/11/1	148ヵ月	1,000,000	948,711	1,054,061	2,354,097	1,354,097	235.41%	10.98%
23	AT2011	2000/12/1	147ヵ月	1,000,000	1,012,677	0,987,481	2,205,400	1,205,400	220.54%	9.84%
24	AT2012	2001/1/4	146ヵ月	1,000,000	1,099,531	0,909,478	2,031,191	1,031,191	203.12%	8.47%
25	AT2101	2001/2/1	145ヵ月	1,000,000	1,106,736	0,903,557	2,017,968	1,017,968	201.80%	8.42%
26	AT2102	2001/3/1	144ヵ月	1,000,000	1,128,441	0,886,718	1,979,154	979,154	197.92%	8.15%
27	AT2103	2001/4/2	143ヵ月	1,000,000	1,274,671	0,784,516	1,752,106	752,106	175.21%	6.31%
28	AT2104	2001/5/1	142ヵ月	1,000,000	1,148,518	0,870,687	1,944,557	944,557	194.46%	7.98%
29	AT2105	2001/6/1	141ヵ月	1,000,000	1,120,460	0,892,490	1,993,251	993,251	199.33%	8.45%
30	AT2106	2001/7/2	140ヵ月	1,000,000	1,095,410	0,912,900	2,038,834	1,038,834	203.88%	8.90%
31	AT2107	2001/8/1	139ヵ月	1,000,000	1,108,831	0,901,850	2,014,155	1,014,155	201.42%	8.75%
32	AT2108	2001/9/3	138ヵ月	1,000,000	1,156,883	0,864,931	1,930,496	930,496	193.05%	8.09%
33	AT2109	2001/10/1	137ヵ月	1,000,000	1,278,225	0,782,334	1,747,233	747,233	174.72%	6.54%
34	AT2110	2001/11/1	136ヵ月	1,000,000	1,323,490	0,755,578	1,687,477	687,477	168.75%	6.06%
35	AT2111	2001/12/3	135ヵ月	1,000,000	1,222,209	0,818,190	1,827,312	827,312	182.73%	7.35%
36	AT2112	2002/1/2	134ヵ月	1,000,000	1,221,883	0,818,408	1,827,799	827,799	182.78%	7.41%
37	AT2201	2002/2/1	133ヵ月	1,000,000	1,166,737	0,857,091	1,914,192	914,192	191.42%	8.25%
38	AT2202	2002/3/1	132ヵ月	1,000,000	1,111,645	0,899,567	2,009,056	1,009,056	200.91%	9.17%
39	AT2203	2002/4/1	131ヵ月	1,000,000	1,098,307	0,910,492	2,033,456	1,033,456	203.35%	9.46%
40	AT2204	2002/5/1	130ヵ月	1,000,000	1,053,547	0,949,174	2,119,847	1,119,847	211.98%	10.33%
41	AT2205	2002/6/3	129ヵ月	1,000,000	1,061,310	0,942,231	2,104,341	1,104,341	210.43%	10.27%
42	AT2206	2002/7/1	128ヵ月	1,000,000	1,182,603	0,845,592	1,888,511	888,511	188.85%	8.32%
43	AT2207	2002/8/1	127ヵ月	1,000,000	1,241,166	0,805,694	1,799,404	799,404	179.94%	7.55%
44	AT2208	2002/9/2	126ヵ月	1,000,000	1,251,288	0,799,176	1,784,847	784,847	178.48%	7.47%
45	AT2209	2002/10/1	125ヵ月	1,000,000	1,344,590	0,743,721	1,660,996	660,996	166.10%	6.34%
46	AT2210	2002/11/1	124ヵ月	1,000,000	1,216,142	0,822,272	1,836,429	836,429	183.64%	8.09%
47	AT2211	2002/12/2	123ヵ月	1,000,000	1,161,070	0,861,274	1,923,534	923,534	192.35%	9.01%
48	AT2212	2003/1/2	122ヵ月	1,000,000	1,278,691	0,782,049	1,746,596	746,596	174.66%	7.34%
49	AT2301	2003/2/3	121ヵ月	1,000,000	1,382,741	0,723,021	1,615,168	615,168	161.52%	6.10%
50	AT2302	2003/3/3	120ヵ月	1,000,000	1,485,812	0,673,302	1,503,122	503,122	150.31%	5.03%
51	AT2303	2003/4/1	119ヵ月	1,000,000	1,366,283	0,731,912	1,634,622	634,622	163.46%	6.40%
52	AT2304	2003/5/1	118ヵ月	1,000,000	1,377,293	0,726,061	1,621,555	621,555	162.16%	6.32%
53	AT2305	2003/6/2	117ヵ月	1,000,000	1,510,066	0,662,222	1,478,980	478,980	147.90%	4.91%
54	AT2306	2003/7/1	116ヵ月	1,000,000	1,436,823	0,695,979	1,554,371	554,371	155.44%	5.73%
55	AT2307	2003/8/1	115ヵ月	1,000,000	1,417,256	0,705,588	1,575,832	575,832	157.58%	6.01%
56	AT2308	2003/9/1	114ヵ月	1,000,000	1,392,804	0,717,976	1,603,498	603,498	160.35%	6.35%
57	AT2309	2003/10/1	113ヵ月	1,000,000	1,416,896	0,705,768	1,576,234	576,234	157.62%	6.12%
58	AT2310	2003/11/4	112ヵ月	1,000,000	1,436,951	0,695,917	1,554,233	554,233	155.42%	5.94%
59	AT2311	2003/12/1	111ヵ月	1,000,000	1,407,221	0,710,620	1,587,070	587,070	158.71%	6.34%
60	AT2312	2004/1/5	110ヵ月	1,000,000	1,506,668	0,663,716	1,482,316	482,316	148.23%	5.26%

契約コード	運用期間	運用開始時			評価日時点					
		運用開始日	期間(月)	投資単位 ②	純資産価値 ③	取得口数 ④	評価額(時価)	評価損益	損益率	年率
							⑤=①×④	⑥=⑤-②	⑦=⑤÷②	⑧
61	AT2401	2004/2/2	109ヵ月	1,000,000	1,515,744	0,659,742	1,473,441	473,441	147.34%	5.21%
62	AT2402	2004/3/1	108ヵ月	1,000,000	1,587,195	0,630,042	1,407,110	407,110	140.71%	4.52%
63	AT2403	2004/4/1	107ヵ月	1,000,000	1,551,768	0,644,426	1,439,235	439,235	143.92%	4.92%
64	AT2404	2004/5/3	106ヵ月	1,000,000	1,429,064	0,699,758	1,562,811	562,811	156.28%	6.37%
65	AT2405	2004/6/1	105ヵ月	1,000,000	1,395,055	0,716,817	1,600,910	600,910	160.09%	6.86%
66	AT2406	2004/7/1	104ヵ月	1,000,000	1,318,409	0,758,489	1,693,978	693,978	169.40%	8.00%
67	AT2407	2004/8/2	103ヵ月	1,000,000	1,313,299	0,761,441	1,700,571	700,571	170.06%	8.16%
68	AT2408	2004/9/1	102ヵ月	1,000,000	1,323,594	0,755,518	1,687,343	687,343	168.73%	8.09%
69	AT2409	2004/10/1	101ヵ月	1,000,000	1,357,884	0,736,439	1,644,733	644,733	164.47%	7.66%
70	AT2410	2004/11/1	100ヵ月	1,000,000	1,408,223	0,710,215	1,586,165	586,165	158.62%	7.03%
71	AT2411	2004/12/1	99ヵ月	1,000,000	1,507,175	0,663,492	1,481,816	481,816	148.18%	5.84%
72	AT2412	2005/1/3	98ヵ月	1,000,000	1,500,722	0,666,345	1,488,188	488,188	148.82%	5.98%
73	AT2501	2005/2/1	97ヵ月	1,000,000	1,412,989	0,707,719	1,580,591	580,591	158.06%	7.18%
74	AT2502	2005/3/1	96ヵ月	1,000,000	1,459,169	0,685,321	1,530,568	530,568	153.06%	6.63%
75	AT2503	2005/4/1	95ヵ月	1,000,000	1,445,096	0,691,995	1,545,473	545,473	154.55%	6.89%
76	AT2504	2005/5/2	94ヵ月	1,000,000	1,402,509	0,713,007	1,592,401	592,401	159.24%	7.56%
77	AT2505	2005/6/1	93ヵ月	1,000,000	1,478,317	0,676,444	1,510,742	510,742	151.07%	6.59%
78	AT2506	2005/7/1	92ヵ月	1,000,000	1,532,845	0,652,381	1,457,001	457,001	145.70%	5.96%
79	AT2507	2005/8/1	91ヵ月	1,000,000	1,551,175	0,644,672	1,439,784	439,784	143.98%	5.80%
80	AT2508	2005/9/1	90ヵ月	1,000,000	1,607,807	0,621,965	1,389,071	389,071	138.91%	5.19%
81	AT2509	2005/10/3	89ヵ月	1,000,000	1,666,428	0,600,085	1,340,205	340,205	134.02%	4.59%
82	AT2510	2005/11/1	88ヵ月	1,000,000	1,637,800	0,610,575	1,363,633	363,633	136.36%	4.96%
83	AT2511	2005/12/1	87ヵ月	1,000,000	1,735,801	0,576,102	1,286,643	286,643	128.66%	3.95%
84	AT2512	2006/1/2	86ヵ月	1,000,000	1,710,516	0,584,616	1,305,662	305,662	130.57%	4.26%
85	AT2601	2006/2/1	85ヵ月	1,000,000	1,752,235	0,570,699	1,274,576	274,576	127.46%	3.88%
86	AT2602	2006/3/1	84ヵ月	1,000,000	1,693,853	0,590,370	1,318,508			

「アセットトライ」に係る手数料等について

参加手数料：申込金額の2.10%（消費税含む。）

解約手数料：解約金額の1.0%（解約時にお客様が受け取る実際の受領金額は、営業者指定銀行における海外送金手数料及びお客様受取銀行における事務手数料が解約償還金額から控除された金額となります。）

管理料：純資産価額の年率1.5%

先物投資顧問料：運用委託額の年率2.0%

成功報酬：運用収益の20%

先物取引手数料：（海外先物取引/海外先渡取引）原則として1枚（往復）当たり上限15米ドル
（外国為替取引）原則として百万米ドル（又は外貨の相当額）に対して上限15米ドル

業務代行報酬：純資産価額の年率0.15%

その他費用（実費）：初期費用、送金銀行に対する手数料、先物運用会社の会計監査費用、営業者及び先物運用会社の期中管理に係る費用、営業者の登録に係る費用、期中に於ける弁護士・税理士費用（ケイマン諸島に於ける弁護士費用を含む。）、関係会社及び先物運用会社のシリーズA株式に係る計算・会計事務に関わる費用、営業者株式の信託会社に対する受託費用・本商品ファンド継続販売のための書面に係る企画・改訂・印刷費用等

管理料、先物投資顧問料、成功報酬、先物取引手数料、業務代行報酬及びその他費用については、事前に計算できないため、当ファンドに係る手数料等の総額または上限額を表示することはできません。

「アセットトライ」に係るリスクと留意点

当ファンドは、先物市場等の値動きにより、大きな収益を得る可能性がある反面、投資元本を割り込む損害を受ける可能性もあるハイリスク・ハイリターンの商品です。投資する商品は多岐にわたり、各々の商品に対して買いのポジションも売りのポジションも持つため、先物市場又は外国為替市場等の特定の指標の値動きが先物運用顧問会社の判断と異なる場合は損失が発生することがあります。当ファンドは元本や収益が保証されているものではありません。資産の一部が外貨建てで運用されるため、為替の変動により収益・損失が増減することがあります。預金保険の適用はありません。当ファンドでは、1口当たりの純資産価額が700,000円を下回った場合には繰上げ償還することがあります。クーリング・オフの適用はありません。投資家が取得する商品ファンド関連受益権は、相続、遺贈、破産その他これらに準ずる場合または金融商品取引業者が転売する場合を除き、第三者には直接譲渡できません。契約締結前交付書面を十分にお読みいただき、当ファンドの特徴とリスクの内容をご理解下さい。

金融商品取引業者の概要

商号：岡藤商事株式会社

登録番号：関東財務局長（金商）第2608号

本店所在地：大阪府大阪市中央区本町3-2-11

加入している金融商品取引業協会：一般社団法人第二種金融商品取引業協会